

タフ・アメリカ (マネープールファンド) 【運用報告書(全体版)】

(2024年2月23日から2024年8月22日まで)

第 22 期

決算日 2024年8月22日

■当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／国内／債券
信託期間	2013年8月28日から2028年8月22日まで
運用方針	マザーファンドへの投資を通じて、安定した収益の確保を図ることを目的として運用を行います。
主要投資対象	当ファンドは以下のマザーファンドを主要投資対象とします。 マネー・マネジメント・マザーファンド 本邦債建て公社債および短期金融商品等
当ファンドの運用方法	■マネー・マネジメント・マザーファンドへの投資を通じて、安定した収益の確保を図ることを目的として運用を行います。
組入制限	当ファンド ■株式への実質投資は行いません。 ■外貨建資産への実質投資は行いません。 マネー・マネジメント・マザーファンド ■株式への投資は行いません。 ■外貨建資産への投資は行いません。
分配方針	■年2回（原則として毎年2月および8月の22日。休業日の場合は翌営業日）決算を行い、分配金額を決定します。 ■分配対象額は、経費控除後の利子、配当等収益と売買益（評価損益を含みます。）等の範囲内とします。 ■分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。 ※委託会社の判断により分配を行わない場合もあるため、将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

マネープールファンドは複利効果による信託財産の成長を優先するため、分配を極力抑制します。
(基準価額水準、市況動向等によっては変更する場合があります。)

受益者の皆さまへ

平素は格別のお引立てに預かり、厚くお礼申し上げます。

当ファンドはマザーファンドへの投資を通じて、安定した収益の確保を図ることを目的として運用を行います。当期についても、運用方針に沿った運用を行いました。

今後ともご愛顧のほどお願い申し上げます。



三井住友DSアセットマネジメント

〒105-6426 東京都港区虎ノ門1-17-1

<https://www.smd-am.co.jp>

■口座残高など、お取引状況についてのお問い合わせ

お取引のある販売会社へお問い合わせください。

■当運用報告書についてのお問い合わせ

コールセンター 0120-88-2976

受付時間：午前9時～午後5時(土、日、祝・休日を除く)

タフ・アメリカ（マネープールファンド）

原則として、各表の数量および金額の単位未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しています。ただし、単位未満の数値については小数を表記する場合があります。

■ 最近5期の運用実績

決算期	基準価額 (分配落)	基準価額			公社債率	純資産額
		税金	込金	騰落率		
	円	円		%	%	百万円
18期（2022年8月22日）	9,952	0	△ 0.0	51.3	3	
19期（2023年2月22日）	9,950	0	△ 0.0	68.6	3	
20期（2023年8月22日）	9,946	0	△ 0.0	56.0	3	
21期（2024年2月22日）	9,946	0	0.0	55.5	2	
22期（2024年8月22日）	9,939	0	△ 0.1	73.8	2	

※基準価額の騰落率は分配金込み。

※当ファンドは親投資信託を組み入れますので、比率は実質比率を記載しています。

※当ファンドの運用方針に対し適切に比較できる指数がないため、ベンチマークおよび参考指数はありません。

■ 当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額	基準価額		公社債率
		騰落率	騰落率	
(期首) 2024年2月22日	円 9,946	% —	% 55.5	
2月末	9,946	0.0	55.5	
3月末	9,948	0.0	55.4	
4月末	9,945	△ 0.0	55.4	
5月末	9,941	△ 0.1	55.4	
6月末	9,941	△ 0.1	55.4	
7月末	9,942	△ 0.0	55.4	
(期末) 2024年8月22日	9,939	△ 0.1	73.8	

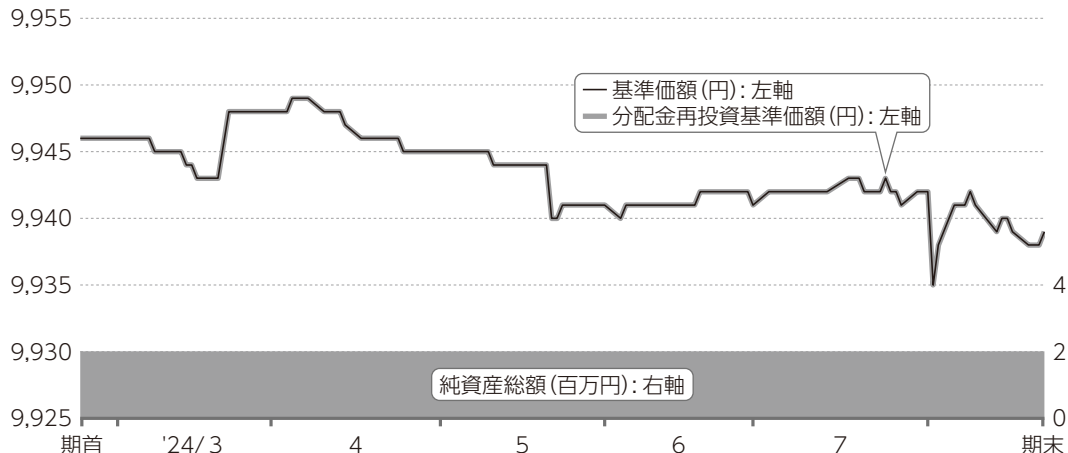
※騰落率は期首比です。

※当ファンドは親投資信託を組み入れますので、比率は実質比率を記載しています。

1 運用経過

基準価額等の推移について (2024年2月23日から2024年8月22日まで)

基準価額等の推移



※分配金再投資基準価額は、期首の値が基準価額と同一となるように指数化しています。

期首	9,946円
期末	9,939円 (既払分配金0円(税引前))
騰落率	-0.1% (分配金再投資ベース)

分配金再投資基準価額について

分配金再投資基準価額は分配金(税引前)を分配時に再投資したと仮定して計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示します。

※分配金を再投資するかどうかについては、受益者の皆さまがご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額などによって課税条件も異なります。したがって、受益者の皆さまの損益の状況を示すものではありません。(以下、同じ)

※当ファンドの運用方針に対し適切に比較できる指数がないため、ベンチマークおよび参考指数はありません。

基準価額の主な変動要因（2024年2月23日から2024年8月22日まで）

当ファンドは、マザーファンドへの投資を通じて、本邦通貨建ての公社債および短期金融商品等に実質的に投資を行いました。

上昇要因

- 実質的に保有している公社債からスプレッド（国債に対する上乗せ金利）分のインカム収入を得たこと

下落要因

- 3月まで、マイナス金利政策を背景として無担保コールレートがマイナス化していたこと

投資環境について（2024年2月23日から2024年8月22日まで）

国内短期金融市場は、マイナス圏からプラス圏へと利回りが上昇しました。

日銀は3月の金融政策決定会合においてマイナス金利政策の解除を行いました。その後、7月末の決定会合において政策金利を+0.25%程度へと引き上げました。

国庫短期証券3ヵ月物の利回りは、期初

はマイナス圏でスタートしましたが、日銀がマイナス金利政策の解除と更なる利上げを行ったことからプラス圏へと浮上しました。期を通じて見ると、概ね-0.10%～+0.10%のレンジ推移となりました。

ポートフォリオについて（2024年2月23日から2024年8月22日まで）

当ファンド

主要投資対象である「マネー・マネジメント・マザーファンド」を、期を通じて高位に組み入れました。

マネー・マネジメント・マザーファンド

安全性と流動性を考慮し、短期の政府保証債を中心とした運用を行いました。年限に関しては、残存6ヵ月以内の短期の政府保証債を中心とした運用を継続しました。

ベンチマークとの差異について（2024年2月23日から2024年8月22日まで）

ベンチマークおよび参考指数を設けていませんので、この項目に記載する事項はありません。

分配金について（2024年2月23日から2024年8月22日まで）

（単位：円、1万口当たり、税引前）

項目	第22期
当期分配金	0
（対基準価額比率）	（0.00%）
当期の収益	-
当期の収益以外	-
翌期繰越分配対象額	589

※単位未満を切り捨てているため、「当期の収益」と「当期の収益以外」の合計が「当期分配金」と一致しない場合があります。
 ※「対基準価額比率」は、「当期分配金」（税引前）の期末基準価額（分配金（税引前）込み）に対する比率で、当ファンドの収益率とは異なります。

期間の分配は、複利効果による信託財産の成長を優先するため、見送りといたしました。

なお、留保益につきましては、運用の基本方針に基づき運用いたします。

2 今後の運用方針

当ファンド

引き続き、運用の基本方針に従い、「マネー・マネジメント・マザーファンド」への投資を通じて、本邦通貨建ての公社債および短期金融商品等に実質的に投資を行い、利息等の収入確保を図ります。

マネー・マネジメント・マザーファンド

日銀は7月の決定会合において、政策金利の引き上げと国債買入れの減額を決定しました。物価安定の目標達成が視野に入らる中で今後も追加利上げを行う可能性が高く、国債買入れの減額も進むことから、国内金利は上昇圧力がかけやすいものと想定し

ます。一方で、先行きの利下げを意識した欧米金利の動向は、国内金利の上昇幅を抑制する見込みです。

当マザーファンドでは引き続き、安全性と流動性をもっとも重視したスタンスでの運用を継続し、短期の国債・政府保証債を中心とした運用を行ってまいります。ファンドの平均残存年限については、2～4ヵ月程度を目安に短めを基本とする方針です。

3 お知らせ

約款変更について

該当事項はございません。

タフ・アメリカ（マネーボールファンド）

1万口当たりの費用明細（2024年2月23日から2024年8月22日まで）

項目	金額	比率	項目の概要
(a) 信託報酬	1円	0.014%	信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率×(経過日数／年日数) 期中の平均基準価額は9,943円です。
（投信会社）	(－)	(－)	投信会社:ファンド運用の指図等の対価
（販売会社）	(1)	(0.014)	販売会社:交付運用報告書等各種資料の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
（受託会社）	(－)	(－)	受託会社:ファンド財産の保管および管理、投信会社からの指図の実行等の対価
(b) 売買委託手数料	－	－	売買委託手数料＝期中の売買委託手数料／期中の平均受益権口数
（株式）	(－)	(－)	売買委託手数料:有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
（先物・オプション）	(－)	(－)	
（投資信託証券）	(－)	(－)	
(c) 有価証券取引税	－	－	有価証券取引税＝期中の有価証券取引税／期中の平均受益権口数
（株式）	(－)	(－)	有価証券取引税:有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
（公社債）	(－)	(－)	
（投資信託証券）	(－)	(－)	
(d) その他費用	0	0.000	その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数
（保管費用）	(－)	(－)	保管費用:海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用
（監査費用）	(－)	(－)	監査費用:監査法人に支払うファンドの監査費用
（その他）	(0)	(0.000)	その他:信託事務の処理等に要するその他費用
合計	1	0.015	

※期中の費用(消費税のかかるものは消費税を含む)は、追加・解約によって受益権口数に変動があるため、簡便法により算出しています。

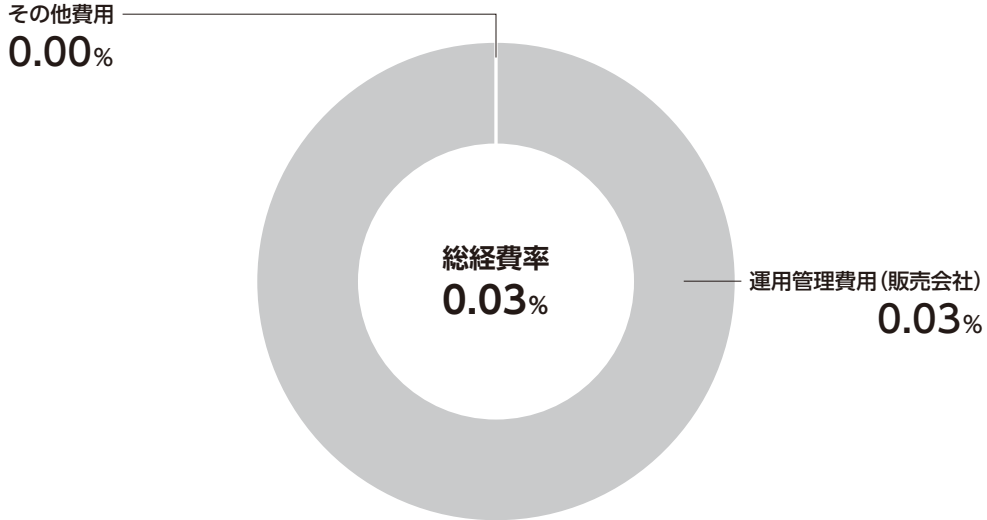
※比率欄は1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

※各項目毎に円未満は四捨五入しています。

※売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、当ファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。



参考情報 総経費率(年率換算)



※各費用は、前掲「1万口当たりの費用明細」において用いた簡便法により算出したもので、原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を含みません。

※各比率は、年率換算した値(小数点以下第2位未満を四捨五入)です。

※上記の前提条件で算出しているため、「1万口当たりの費用明細」の各比率とは、値が異なる場合があります。なお、これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率とは異なります。

当期中の運用・管理にかかった費用の総額(原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を除く。)を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額(1口当たり)を乗じた数で除した総経費率(年率換算)は0.03%です。

タフ・アメリカ（マネープールファンド）

■ 当期中の売買及び取引の状況（2024年2月23日から2024年8月22日まで）

親投資信託受益証券の設定、解約状況

	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
マネー・マネジメント・マザーファンド	千口 1	千円 1	千口 2	千円 2

■ 利害関係人との取引状況等（2024年2月23日から2024年8月22日まで）

利害関係人との取引状況

タフ・アメリカ（マネープールファンド）

当期中における利害関係人との取引等はありません。

マネー・マネジメント・マザーファンド

区 分	買付額等 A			売付額等 C		
	うち利害関係人 との取引状況B	B A	%	うち利害関係人 との取引状況D	D C	%
公 社 債	百万円 2	百万円 50.0	% 50.0	百万円 -	百万円 -	% -

※平均保有割合 37.1%

※平均保有割合とは、親投資信託の残存口数の合計に対する当該ベビーファンドの親投資信託所有口数の割合。

利害関係人とは、投資信託および投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当期における当ファンドに係る利害関係人とは、SMB C日興証券株式会社です。

■ 第一種金融商品取引業、第二種金融商品取引業又は商品取引受託業務を兼業している委託会社の自己取引状況

（2024年2月23日から2024年8月22日まで）

該当事項はございません。また委託会社に売買委託手数料は支払われておりません。

■ 自社による当ファンドの設定・解約状況（2024年2月23日から2024年8月22日まで）

期首残高 (元)	当期設定 本	当期解約 本	期末残高 (元)	取 引 の 理 由
百万円 1	百万円 -	百万円 -	百万円 1	当初設定時または当初運用時における取得等

■ 組入れ資産の明細（2024年8月22日現在）

親投資信託残高

種 類	期 首（前期末）	期 末		
	口 数	口 数	評 価	額
マネー・マネジメント・マザーファンド	千口 1,971	千口 1,969	千円	1,960

※マネー・マネジメント・マザーファンドの期末の受益権総口数は5,311,327口です。

■ 投資信託財産の構成

（2024年8月22日現在）

項 目	期	末
	評 価 額	比 率
マネー・マネジメント・マザーファンド	千円 1,960	% 97.5
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	49	2.5
投 資 信 託 財 産 総 額	2,010	100.0

タフ・アメリカ（マネー・プールファンド）

■ 資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2024年8月22日現在)

項 目	期 末
(A) 資 産	2,010,706円
コール・ローン等	49,477
マネー・マネジメント・マザーファンド(評価額)	1,960,936
未 収 入 金	293
(B) 負 債	292
未 払 信 託 報 酬	292
(C) 純 資 産 総 額(A - B)	2,010,414
元 本	2,022,677
次 期 繰 越 損 益 金	△ 12,263
(D) 受 益 権 総 口 数	2,022,677口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額 (C / D)	9,939円

※当期における期首元本額2,023,683円、期中追加設定元本額1,006円、期中一部解約元本額2,012円です。

※上記表中の次期繰越損益金がマイナス表示の場合は、当該金額が投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第10号に規定する額（元本の欠損）となります。

※上記表中の受益権総口数および1万口当たり基準価額が、投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第7号および第11号に規定する受益権の総数および計算口数当たりの純資産の額となります。

■ 損益の状況

(自2024年2月23日 至2024年8月22日)

項 目	当 期
(A) 有 価 証 券 売 買 損 益	△ 984円
売 買 損 益	△ 984
(B) 信 託 報 酬 等	△ 292
(C) 当 期 損 益 金(A + B)	△ 1,276
(D) 前 期 繰 越 損 益 金	△ 6,445
(E) 追 加 信 託 差 損 益 金	△ 4,542
(配 当 等 相 当 額)	(54,364)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△58,906)
(F) 合 計(C + D + E)	△ 12,263
次 期 繰 越 損 益 金(F)	△ 12,263
追 加 信 託 差 損 益 金	△ 4,542
(配 当 等 相 当 額)	(54,364)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△58,906)
分 配 準 備 積 立 金	64,822
繰 越 損 益 金	△72,543

※有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

※株式投信の信託報酬等には消費税等相当額が含まれており、公社債投信には内訳の一部に消費税等相当額が含まれています。

※追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

※分配金の計算過程は以下の通りです。

項 目	当 期
(a) 経費控除後の配当等収益	3,160円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0
(c) 収益調整金	54,364
(d) 分配準備積立金	61,662
(e) 当期分配対象額(a + b + c + d)	119,186
1 万 口 当 た り 当 期 分 配 対 象 額	589.25
(f) 分配金	0
1 万 口 当 た り 分 配 金	0

■ 分配金のお知らせ

1 万 口 当 た り 分 配 金 (税 引 前)	当 期
	0円

上記のほか、投資信託財産の計算に関する規則第58条第1項各号に該当する事項はありません。

マネー・マネジメント・マザーファンド

第11期（2023年7月26日から2024年7月25日まで）

信託期間	無期限（設定日：2013年6月3日）
運用方針	■本邦通貨建て公社債および短期金融商品等に投資を行い、利息等収入の確保を図ります。

原則として、各表の数量および金額の単位未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しています。ただし、単位未満の数値については小数を表記する場合があります。

■ 最近5期の運用実績

決 算 期	基 準	価 額		公 組 入 社 比	債 率	純 総 資 産 額
		騰 落	中 率			
7期（2020年7月27日）	円		%		%	百万円
	9,979		△0.1		88.0	27
8期（2021年7月26日）	9,972		△0.1		62.4	27
9期（2022年7月25日）	9,967		△0.1		80.9	17
10期（2023年7月25日）	9,960		△0.1		70.9	7
11期（2024年7月25日）	9,957		△0.0		75.7	5

※当ファンドの運用方針に対し適切に比較できる指数がないため、ベンチマークおよび参考指数はありません。

■ 当期中の基準価額と市況等の推移

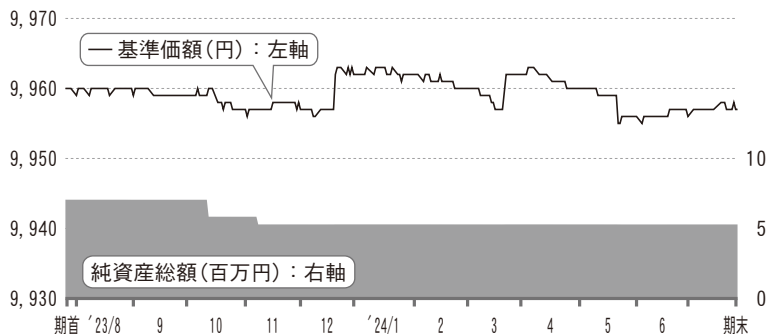
年 月 日	基 準	価 額		公 組 入 社 比	債 率
		騰 落	率		
(期 首) 2023年7月25日	円		%		%
	9,960		—		70.9
7月末	9,959		△0.0		56.8
8月末	9,959		△0.0		56.9
9月末	9,959		△0.0		71.1
10月末	9,957		△0.0		68.7
11月末	9,957		△0.0		56.9
12月末	9,962		0.0		56.9
2024年1月末	9,962		0.0		56.9
2月末	9,960		0.0		56.9
3月末	9,962		0.0		56.8
4月末	9,960		0.0		56.8
5月末	9,956		△0.0		56.8
6月末	9,956		△0.0		56.8
(期 末) 2024年7月25日		9,957	△0.0		75.7

※騰落率は期首比です。

1 運用経過

▶ 基準価額等の推移について（2023年7月26日から2024年7月25日まで）

基準価額等の推移



期首	9,960円
期末	9,957円
騰落率	-0.0%

▶ 基準価額の主な変動要因（2023年7月26日から2024年7月25日まで）

当ファンドは、本邦通貨建ての公社債および短期金融商品等を主要投資対象とし、安定した収益の確保を図ることを目的として運用を行いました。

上昇要因	<ul style="list-style-type: none"> 保有している公社債からスプレッド（国債に対する上乗せ金利）分のインカム収入を得たこと
下落要因	<ul style="list-style-type: none"> マイナス金利政策導入を背景として無担保コールレートがマイナス化していたこと マイナス金利解除を背景に国内金利が上昇基調で推移し、債券価格が下落したこと

▶ **投資環境について（2023年7月26日から2024年7月25日まで）**

期間における国内短期金融市場は下落しました。

日本銀行は2023年7月以降、長短金利操作の運用を柔軟化するなどの政策変更を行い、国内金利は上昇基調で推移しました。2024年3月の日銀金融政策決定会合においては、マイナス金利の解除やイールドカーブ・コントロール（長短金利操作）廃止を決定したほか、日銀当座預金付利金利を0.1%に引き上げることで、無担保コール翌日金利を0～0.1%程度で推移するよう促すことも決定しました。

期初にマイナス圏で推移していた国庫短期証券3ヵ月物利回りは、日本銀行がマイナス金利を解除した3月中旬以降はプラスに転じ、その後は0%近辺で推移しました。

▶ **ポートフォリオについて（2023年7月26日から2024年7月25日まで）**

安全性と流動性を考慮し、短期の政府保証債を中心とした運用を行いました。年限に関しては、残存6ヵ月以内の短期の政府保証債を中心とした運用を継続しました。

▶ **ベンチマークとの差異について（2023年7月26日から2024年7月25日まで）**

ベンチマークおよび参考指数を設けていませんので、この項目に記載する事項はありません。

2 今後の運用方針

日本銀行は7月の金融政策決定会合において、政策金利を0.25%へ引き上げることや長期国債買入れの段階的な減額を決定しました。植田日銀総裁は、展望レポートで示した経済・物価見通しが実現するのであれば引き続き利上げを行う可能性を示しており、国内金利は上昇圧力がかかりやすいものと想定します。当ファンドでは引き続き、安全性と流動性をもっとも重視したスタンスでの運用を継続し、短期の国債・政府保証債を中心とした運用を行っていきます。ファンドの平均残存年限については、2～4ヵ月程度を目安に短めを基本とする方針です。

■ 1万口当たりの費用明細 (2023年7月26日から2024年7月25日まで)

項目	金額	比率	項目の概要
(a) その他費用 (その他)	0円 (0)	0.004% (0.004)	その他費用=期中のその他費用/期中の平均受益権口数 その他: 信託事務の処理等に要するその他費用
合計	0	0.004	

期中の平均基準価額は9,959円です。

※期中の費用（消費税のかかるものは消費税を含む）は、追加・解約によって受益権口数に変動があるため、簡便法により算出しています。
※比率欄は1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

※各項目毎に円未満は四捨五入しています。

■ 当期中の売買及び取引の状況 (2023年7月26日から2024年7月25日まで)

公社債

		買付額	売付額
		千円	千円
国内	特殊債券	9,029	1,002 (9,000)

※金額は受渡し代金。（経過利子分は含まれておりません。）

※（ ）内は償還等による減少分で、上段の数字には含まれておりません。

■ 利害関係人との取引状況等 (2023年7月26日から2024年7月25日まで)

利害関係人との取引状況

区分	買付額等 A			売付額等 C		
	うち利害関係人との取引状況B	B/A		うち利害関係人との取引状況D	D/C	
公社債	百万円 9	百万円 5	% 55.6	百万円 1	百万円 -	% -

利害関係人とは、投資信託および投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当期における当ファンドに係る利害関係人とは、SMB C日興証券株式会社です。

■ 第一種金融商品取引業、第二種金融商品取引業又は商品取引受託業務を兼業している委託会社の自己取引状況
(2023年7月26日から2024年7月25日まで)

該当事項はございません。また委託会社に売買委託手数料は支払われておりません。

■ 組入れ資産の明細 (2024年7月25日現在)

公社債

A 債券種類別開示

国内(邦貨建)公社債

区分	期				末		
	額面金額	評価額	組入比率	うちBBB格以下 組入比率	残存期間別組入比率		
					5年以上	2年以上	2年未満
	千円	千円	%	%	%	%	%
特殊債券 (除く金融債券)	4,000 (4,000)	4,004 (4,004)	75.7 (75.7)	— (—)	— (—)	— (—)	75.7 (75.7)
合計	4,000 (4,000)	4,004 (4,004)	75.7 (75.7)	— (—)	— (—)	— (—)	75.7 (75.7)

※()内は非上場債で内書きです。

※組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

B 個別銘柄開示

国内(邦貨建)公社債

種類	銘柄	期		末	
		利率	額面金額	評価額	償還年月日
		%	千円	千円	
特殊債券 (除く金融債券)	222 政保道路機構	0.6010	1,000	1,000	2024/07/31
	236 政保道路機構	0.3200	1,000	1,000	2025/01/31
	69政保地方公共団	0.4140	1,000	1,001	2025/02/17
	70政保地方公共団	0.4500	1,000	1,001	2025/03/14
小	計	—	4,000	4,004	—
合	計	—	4,000	4,004	—

■ 投資信託財産の構成

(2024年7月25日現在)

項目	期		末	
	評価額	比率	評価額	比率
公社債	千円	%	千円	%
	4,004	75.7	4,004	75.7
コール・ローン等、その他	1,284	24.3	1,284	24.3
投資信託財産総額	5,288	100.0	5,288	100.0

■ 資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2024年7月25日現在)

項 目	期 末
(A) 資 産	5,288,730円
コール・ローン等	1,278,429
公社債(評価額)	4,004,516
未収利息	3,530
前払費用	2,255
(B) 純資産総額(A)	5,288,730
元 本	5,311,622
次期繰越損益金	△ 22,892
(C) 受益権総口数	5,311,622口
1万口当たり基準価額(B/C)	9,957円

※当期における期首元本額7,084,714円、期中追加設定元本額1,005円、期中一部解約元本額1,774,097円です。

※上記表中の次期繰越損益金がマイナス表示の場合は、当該金額が投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第10号に規定する額(元本の欠損)となります。

※期末における元本の内訳は以下の通りです。

タフ・アメリカ(マネーボールファンド)	1,970,096円
日本株アルファ・カルテット(毎月分配型)	1,998,801円
米国リバーサル戦略ツインαネオ(毎月分配型)	1,312,751円
日本株アルファ・カルテット(年2回決算型)	9,990円
大和住銀/コロンビア米国株リバーサル戦略ファンド Aコース(ダイワ投資一任専用)	9,992円
大和住銀/コロンビア米国株リバーサル戦略ファンド Bコース(ダイワ投資一任専用)	9,992円

※上記表中の受益権総口数および1万口当たり基準価額が、投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第7号および第11号に規定する受益権の総数および計算口数当たりの純資産の額となります。

■ お知らせ

<約款変更について>

・デリバティブ取引の利用目的を明確化するため、信託約款に所要の変更を行いました。

(適用日：2023年9月29日)

■ 損益の状況

(自2023年7月26日 至2024年7月25日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	21,901円
受 取 利 息	22,407
支 払 利 息	△ 506
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△23,639
売 買 損	△23,639
(C) そ の 他 費 用 等	△ 241
(D) 当 期 損 益 金(A + B + C)	△ 1,979
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	△28,299
(F) 解 約 差 損 益 金	7,391
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	△ 5
(H) 合 計(D + E + F + G)	△22,892
次 期 繰 越 損 益 金(H)	△22,892

※有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

※追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

※解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。